

CIERRE DE INSTRUMENTOS DE RENTA FIJA
29 de Octubre 2020



Ticker	Bonos CER	Px	TIR	TNA Spread	MD	Paridad
TX21	Bonos del Tesoro Nacional Vto 05-08-2021	119,8	4%	4%	0,74	97%
TX22	Bonos del Tesoro Nacional Vto 18-03-2022	111,0	6%	6%	1,32	94%
TX23	Bonos del Tesoro Nacional Vto 25-03-2023	102,0	8%	7%	2,27	87%
TX24	Bonos del Tesoro Nacional Vto 25-03-2024	93,5	9%	8%	3,16	80%
T2X2	Bonos del Tesoro Nacional Vto 20-09-2022	101,7	9%	8%	1,31	91%
PR13	Bono de Consolidación Serie 6 vto. 15-03-24	625,0	7%	7%	1,63	91%
TC21	Boncer - vto. 22-07-2021	377,1	6%	6%	0,69	98%
TC23	Boncer - vto. 06-03-2023	253,0	7%	7%	2,16	93%
TC25p	Boncer - vto. 27-04-2025	205,0	10%	10%	3,89	79%
TX26	Bonos del Tesoro Nacional Vto 09-11-2026	70,9	11%	11%	4,43	67%
TX28	Bonos del Tesoro Nacional Vto 09-11-2028	68,0	11%	11%	4,88	65%
DICP	Bono Discount - vto. 31-12-2033	1640,0	10%	10%	5,73	78%
PARP	Bono PAR - vto. 31-12-2038	669,9	10%	10%	10,02	41%
CUAP	Bono Cuasipar - vto. 31-12-2045	1049,5	10%	9%	10,90	46%

Ticker	Bonos Tasa Fija	Px	TIR	TNA	MD	Paridad
TO21	Bono del Tesoro Nacional 18,2% vto. 03-10-21	77,3	62%	55%	0,66	76%
TO23	Bono del Tesoro Nacional 16% vto. 17-10-23	49,3	58%	52%	1,71	49%
TO26	Bono del Tesoro Nacional 15,5% vto. 17-10-26	36,5	56%	50%	2,17	36%

Ticker	Bonos BADLAR Sob	Px	TIR	TNA Spread	MD	Paridad
PR15	Bono Consolidación Serie 8 - Vto. 04-10-22	97,0	56%	16%	0,89	88%
TB21	Bono del Tesoro Nacional vto 05-08-2021	101,6	49%	11%	0,65	94%
S22D0	Lebad vto 22-12-2020	126,0	39%	2%	0,14	99%

Ticker	Bonos BADLAR SubSob	Px	TIR	TNA Spread	MD	Paridad
PBY22	Bono de la Prov de BS AS - Badlar + 3.83 % VTO 31-05-2022	86,8	61%	22%	1,20	82%
PBA25	Bono de la Prov de BS AS - Badlar + 3.75 % VTO 12-04-2025	70,9	65%	22%	2,00	69%
BDC22	Bono de la Ciudad de BS AS - Badlar + 5 % VTO 23-01-2022	98,5	45%	8%	1,03	98%
BDC24	Bono de la Ciudad de BS AS - Badlar + 3.25 % VTO 29-03-2024	88,0	52%	12%	1,94	85%
BDC28	Bono de la Ciudad de BS AS - Badlar + 3.75 % VTO 22-02-2028	92,0	46%	10%	2,53	85%

TNA Spread = Premium Over Rate



Dólar Mep \$ 144,19

Dólar CCL \$ 151,22

Ticker	TIR	Duration	Precio
AL29	15,7%	5,04	USD 44,66
AL30	16,8%	5,27	USD 38,70
AL35	14,8%	8,15	USD 35,93
AE38	16,9%	6,78	USD 36,34
AL41	15,4%	7,59	USD 33,98
GD29	14,4%	5,13	USD 47,85
GD30	16,4%	5,30	USD 39,56
GD35	14,6%	8,18	USD 36,41
GD38	14,0%	7,28	USD 44,39
GD41	14,1%	7,92	USD 37,80
GD46	14,6%	7,61	USD 36,41

Bonos Soberanos en Dólares

